

Aviso: [2019-06-17 19:33] este documento é uma impressão do portal Ciência-IUL e foi gerado na data indicada. O documento tem um propósito meramente informativo e representa a informação contida no portal Ciência-IUL nessa data.

João Pedro Vidal Nunes

Professor Catedrático

Departamento de Finanças (IBS)

Coordenador

UNIDE-IUL - Unidade de Investigação em Desenvolvimento Empresarial (IBS)
[Finance Group]

Investigador Integrado

UNIDE-IUL - Unidade de Investigação em Desenvolvimento Empresarial (IBS)
[Finance Group]



Contactos

E-mail	joao.nunes@iscte-iul.pt
Gabinete	D5.31
Telefone	217650526 (Ext: 220151)
Cacifo	103-A

Qualificações Académicas

Universidade/Instituição	Tipo	Curso	Período
University of Warwick	Doutoramento	Gestão	2000
Instituto Superior de Economia e Gestão - UTL	Mestrado	Economia	1994
ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa	Licenciatura	Organização e Gestão de Empresas	1990

Unidades Curriculares Lecionadas (no ano lectivo corrente)

Ano Letivo	Semestre	Nome da Unidade Curricular	Coordenador
2018/2019	1º	Finanças em Tempo Contínuo	Sim
2018/2019	1º	Investimentos	Sim
2018/2019	1º	Investimentos (Mf)	Sim
2018/2019	1º	Modelos, Estrutura Temporal e Taxa de Juro	Sim
2018/2019	2º	Investimentos	Sim
2018/2019	2º	Opções Exóticas	Sim

Orientações

• Teses de Doutoramento

- Terminadas

	Tipo de Orientação	Nome do Estudante	Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Co-Orientador	João Pedro Ruas	Three Essays on the Valuation of American-style Options	Inglês	ISCTE-IUL	2013

• Dissertações de Mestrado

- Em curso

	Tipo de Orientação	Nome do Estudante	Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Orientador	Vyacheslav Kostyuk	Pricing of VIX futures through the Heston (1993) model	--	Em curso	ISCTE-IUL
2	Orientador	Mariana Beatriz Papoila Magalhães Martins Coelho	The SVIX index: a predictor of the market risk premium	--	Em curso	ISCTE-IUL

- Terminadas

	Tipo de Orientação	Nome do Estudante	Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Orientador	João Luís Gomes Ferreira Campos Andrada	Modelização paramétrica da superfície de volatilidade implícita	Português	ISCTE-IUL	2018
2	Orientador	Ricardo Manuel Santos Oliveira Tomaz	The Market Value of Corporate Votes: Another Approach.	Inglês	ISCTE-IUL	2017

3	Orientador	João Miguel Sousa Machado Castilho Borges	Impacto da Política do Quantitative Easing num Portfólio de Investimento	Português	ISCTE-IUL	2017
4	Orientador	Inês Sofia Morais Ferreira	Opções sobre commodities	Português	ISCTE-IUL	2016
5	Orientador	Bruno Filipe Soares dos Santos Sousa	Credit Valuation Adjustment	Inglês	ISCTE-IUL	2016
6	Orientador	Ricardo Nuno Santos Aleixo de Matos	Stochastic Volatility Jump-diffusion Models us time-changed levy Processes	Inglês	ISCTE-IUL	2014
7	Orientador	Pedro Simões Oliveira	The corvolution method for pricing American options under levy processes	Inglês	ISCTE-IUL	2014
8	Orientador	Igor Viktorovich Kravchenko	Barrier Option Pricing Via Heston Model	Inglês	ISCTE-IUL	2013
9	Orientador	João Pedro Bento Ruas	Three Essays on the valuation of American-style options	Inglês	ISCTE-IUL	2013
10	Orientador	Sara Alexandra da Costa Veloso	O Modelo Fiscal de Avaliação de Prédios Urbanos e o Ciclo Económico do País	Português	ISCTE-IUL	2013

• Projetos Finais de Mestrado

- Terminadas

	Tipo de Orientação	Nome do Estudante	Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Orientador	Margarida Dinis Silvestre	Pateo Wine Bar & Heritage Shop	Inglês	ISCTE-IUL	2012
2	Orientador	Sara Isabel Poço Ramos	Decomposição, Avaliação e Hedging de um Produto Estruturado	Português	ISCTE-IUL	2012
3	Orientador	Tiago Miguel Vargas Tavares	Modelos de Taxa de Juro após a Crise de Crédito e Liquidez	Português	ISCTE-IUL	2012
4	Orientador	Iva Bagic	Singue and Combined Option Trading Strategies.	--	ISCTE-IUL	2011
5	Orientador	Arne Neumann	Assembly and Preparation for the Derivative Market - A Convenience Comparison Between Financial Options and Futures with View to the Eurex and Liffe.	--	ISCTE-IUL	2011
6	Orientador	William Hilebrand	The Valuation of Callable Defaultable Bonds.	--	ISCTE-IUL	2011
7	Orientador	Filipa Isabel Ferreira Alcaide	Covered Bond Market - Is Legislation Impact Measurable?	Inglês	ISCTE-IUL	2011

8	Orientador	Luís Filipe Dôres Veiga		--	ISCTE-IUL	2011
9	Orientador	Jorge Alexandre Rodrigues Domingues		--	ISCTE-IUL	2011
10	Orientador	Maria da Graça Teixeira Duarte de Aguiar Câmara	O Efeito Smile - Uma Aplicação ao DAX.	Português	ISCTE-IUL	2010
11	Orientador	Cláudia Patrícia Gonçalves Simões	Euro Área Inflation-Linked Bonds Market: Analysis and immunization abilities.	Português	ISCTE-IUL	2010
12	Orientador	Diogo Monteiro da Costa Soares Justino	Hedging of Barrier Options.	Português	ISCTE-IUL	2010
13	Orientador	Aloísio Bragança Gomes Will	Ambidiesel - Produção de Combustíveis Alternativos.	Português	ISCTE-IUL	2010
14	Orientador	Carina Sofia Ferreira da Silva	O Mercado Organizado de CO2 - Oportunidade de Investimento e Melhoria do Ambiente Compatíveis?	Português	ISCTE-IUL	2009
15	Orientador	Fernando Manuel de Deus Infante	Basileia II: Análise das Implicações do Pilar 2 na Organização do Processo de Supervisão.	Português	ISCTE-IUL	2009

Total de Citações

Web of Science®	97
Scopus	119

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

1	Nunes, J. P. V., Dias, J. C. & Ruas, J. P. (2018). The early exercise boundary under the jump to default extended CEV model. Applied Mathematics and Optimization. NA - N.º de citações Scopus: 1
2	Dias, J. C. & Nunes, J. P. V. (2017). Universal recurrence algorithm for computing Nuttall, generalized Marcum and incomplete Toronto functions and moments of a noncentral x2 random variable. European Journal of Operational Research . 265 (2), 559-570
3	Ruas, J. P., Nunes, J. P. V. & Dias, J. C. (2016). In-out parity relations for American-style barrier options. Journal of Derivatives. 23 (4), 20-32 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1

4	Nunes, J. P. V. & Alcaria, T. R. V. (2016). Valuation of forward start options under affine jump-diffusion models. <i>Quantitative Finance</i> . 16 (5), 727-747
5	Dias, J. C., Nunes, J. P. V. & Ruas, J. P. (2015). Pricing and static hedging of european-style double barrier options under the jump to default extended CEV model. <i>Quantitative Finance</i> . 15 (12), 1995-2010 - N.º de citações Web of Science®: 4 - N.º de citações Scopus: 5
6	Nunes, J., Ruas, J. & Dias, J. C. (2015). Pricing and static hedging of American-style knock-in options on defaultable stocks. <i>Journal of Banking and Finance</i> . 58, 343-360 - N.º de citações Web of Science®: 4 - N.º de citações Scopus: 5
7	Oliveira, L., Nunes, J. & Malcato, L. (2014). The performance of deterministic and stochastic interest rate risk measures: another question of dimensions?. <i>Portuguese Economic Journal</i> . 13 (3), 141-165
8	Nunes, J. & Prazeres, P. (2014). Pricing swaptions under multifactor gaussian HJM models. <i>Mathematical Finance</i> . 24 (4), 762-789 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 2
9	Ruas, J. P., Dias, J. C. & Nunes, J. (2013). Pricing and static hedging of American-style options under the jump to default extended CEV model. <i>Journal of Banking and Finance</i> . 37 (11), 4059-4072 - N.º de citações Web of Science®: 9 - N.º de citações Scopus: 9
10	Oliveira, L., Curto, J. D. & Nunes, J. P. (2012). The determinants of sovereign credit spread changes in the Eurozone. <i>Journal of International Financial Markets, Institutions & Money</i> . 22 (2), 278-304 - N.º de citações Web of Science®: 31 - N.º de citações Scopus: 37
11	Dias, J. C. & Nunes, J. P. (2011). Pricing real options under the constant elasticity of variance diffusion. <i>Journal of Futures Markets</i> . 31 (3), 230-250 - N.º de citações Web of Science®: 14 - N.º de citações Scopus: 18
12	Nunes, J. P. V. (2011). American options and callable bonds under stochastic interest rates and endogenous bankruptcy. <i>Review of Derivatives Research</i> . 14 (3), 283-332 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1
13	Nunes, J. (2009). Pricing American Options under the Constant Elasticity of Variance Model and Subject to Bankruptcy. <i>Journal of Financial and Quantitative Analysis</i> . 44, 1231-1263 - N.º de citações Web of Science®: 19 - N.º de citações Scopus: 21
14	Nunes, J. P. V. & Oliveira, L. A. F. (2007). Multifactor and analytical valuation of treasury bond futures with an embedded quality option. <i>Journal of Futures Markets</i> . 27 (3), 275-303 - N.º de citações Web of Science®: 3
15	Nunes, J. P. V. (2006). Barrier options on spot LIBOR rates under multi-factor Gaussian HJM models. <i>Journal of Derivatives</i> . 14 (1), 61-81 - N.º de citações Scopus: 2

16	Nunes, J. P. V. (2004). Multifactor valuation of floating range notes. <i>Mathematical Finance</i> . 14 (2), 79-97 - N.º de citações Web of Science®: 10 - N.º de citações Scopus: 9
17	Nunes, J. P. V. (2004). A general equilibrium framework for the affine class of term structure models. <i>Portuguese Economic Journal</i> . 3 (1), 15-48
18	Nunes, J., Clewlow, L. & Hodges, S. (1999). Interest Rate Derivatives in a Duffie and Kan Model with Stochastic Volatility: An Arrow-Debreu Pricing Approach. <i>Review of Derivatives Research</i> . 3, 5-66 - N.º de citações Scopus: 8
19	Nunes, J. (1998). Interest Rate Options in a Duffie-Kan Model with Deterministic Volatility. <i>Portuguese Review of Financial Markets</i> . 1, 63-101

• Livros e Capítulos de Livros

- Autor de livro

1	Barroso, C., Mota, A., Oliveira, L., Nunes, J. & Inácio, P. (2015). <i>Finanças da Empresa: Teoria e Prática</i> (edição revista e aumentada). Lisboa. Sílabo.
2	Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Oliveira, L., Ferreira, M. & Inácio, P. (2015). <i>Finanças da Empresa: Teoria e Prática</i> . Lisboa. Sílabo.
3	Barroso, C., Mota, A., Nunes, J. & Ferreira, M. (2012). <i>Finanças da Empresa - Teoria e Prática</i> . Lisboa. Edições Sílabo.
4	Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Oliveira, L. & Ferreira, M. (2012). <i>Investimentos Financeiros: teoria e prática</i> . Portugal . Edições Sílabo .
5	Barroso, C., Mota, A., Nunes, J. & Ferreira, M. (2010). <i>Finanças da Empresa _ Teoria e Prática</i> . Edições Sílabo.
6	Oliveira, L., Mota, A., Barroso, C. & Nunes, J. (2009). <i>Investimentos Financeiros: Teoria e prática</i> . Lisboa/Portugal. Edições Sílabo.

- Editor de livro

1	Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Miguel A. Ferreira & Oliveira, L. (2012). <i>Finanças da Empresa: Teoria e Prática</i> . Lisboa/Portugal. Sílabo.
2	Mota, António, Barroso, C., Nunes, J. & Miguel A. Ferreira (2011). <i>Finanças da Empresa Teoria e Prática</i> . Portugal. Sílabo.

• Outras Publicações

- Artigo sem avaliação científica

1	Oliveira, L. & Nunes, J. (2012). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. SSRN. 0-0
2	Oliveira, L. & Nunes, J. (2008). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures . SSRN. 0-0

- Outras publicações

1	Ruas, J., Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Erratum to "Pricing and static hedging of American-style options under the jump to default extended CEV model" (Journal of Banking and Finance (2013) 37(11) (4059–4072) (S0378426613002896) (10.1016/j.jbankfin.2013.07.019)). Journal of Banking and Finance. 81, 20-23
2	Nunes, J., Pereira da Silva, C. & Cadete, J. (2003). The Immunisation of a Workers' Compensation Fund. Bulletin of the Portuguese Institute of Actuaries. 42, 11-39

• Conferências/Workshops e Comunicações

- Comunicação em evento científico

1	Ruas, J., Nunes, J. & Dias, J. C. (2018). Early Exercise Boundaries for American-style Knock-Out Options. 10th World Congress of the Bachelier Finance Society.
2	Dias, J. C. & Nunes, J. (2018). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 12th Workshop on Statistics, Mathematics and Computation.
3	Dias, J. C. & Nunes, J. (2018). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 10th International Conference of the Portuguese Finance Network.
4	Leite, J., Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Computation of Three Discrete Distribution Mixtures of Continuous Distributions: Stability Analysis. 11th International Conference on Computational and Financial Econometrics.
5	Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. XXIII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
6	Leite, J., Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Cálculo Computacional de Misturas Discretas de Distribuições Contínuas: Revisão do Método de Benton e Krishnamoorthy. XXIII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
7	Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 2nd International Conference on Computational Finance.
8	Dias, J. C., Laureano, L. & Nunes, J. (2017). Corporate Security Valuation under a Barrier Option Framework with State-Dependent Volatility. 5th Paris Financial Management Conference.
9	Dias, J. C. & Nunes, J. (2016). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 9th World Congress of the Bachelier Finance Society.
10	Nunes, J., Dias, J. C. & Ruas, J. (2016). The Early Exercise Boundary under the Jump to Default Extended CEV Model. 9th World Congress of the Bachelier Finance Society.
11	Nunes, J., Ruas, J. & Dias, J. C. (2014). Static Hedging and Early Exercise Boundaries for American-style Barrier Options. 8th World Congress of the Bachelier Finance Society.
12	Dias, J. C., Nunes, J. & Ruas, J. (2014). Pricing and Static Hedging of American-style Double Knock-In Options. Mathematical Finance Workshop: Stochastic Analysis and Numerical Approximations in Mathematical Finance.

13	Dias, J. C., Nunes, J. & Ruas, J. (2014). Pricing and Static Hedging of European-style Double Barrier Options under the Jump to Default Extended CEV Model. 8th International Conference of the Portuguese Finance Network.
14	Dias, J.C., Nunes, J.P. & Ruas, J. P. (2013). In-Out Parity Relations and Early Exercise Boundaries for American-Style Barrier Options. FMA 17th European Conference.
15	Dias, J.C., Nunes, J.P. & Ruas, J. P. (2013). Pricing and Static Hedging of American Options under the Jump to Default Extended CEV Model. FMA 17th European Conference.
16	Nunes, J. & Oliveira, L. (2013). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. 7th Annual Meeting of the Portuguese Economic Journal.
17	Nunes, J. & Oliveira, L. (2013). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. FMA Europe 2013 Meeting.
18	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. Mathematical Finance Days Conference.
19	Nunes, J. & Ruas, J. (2012). The Implied Volatility Bias: A No-Arbitrage Approach for Short-Dated Options. EFMA 2012 Meeting.
20	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). Pricing Double Barrier Options under the CEV Process: A Speed-Accuracy Comparison of Alternative Methods. 7th World Congress of the Bachelier Finance Society.
21	Nunes, J. & Prazeres, P. (2012). Pricing Swaptions under Multifactor Gaussian HJM Models. SIAM Conference on Financial Mathematics and Engineering.
22	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. 7th International Conference of the Portuguese Finance Network.
23	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. SIAM Conference on Financial Mathematics & Engineering.
24	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). Truncated Moments of a Noncentral χ^2 Random Variable: An Extension of the Benton and Krishnamoorthy Approach. XX Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
25	Dias, J.C., Nunes, J.P. & Ruas, J. P. (2012). Pricing and Static Hedging of American Options under the Jump to Default Extended CEV Model. INFORMS Annual Meeting.
26	Nunes, J. & Prazeres, P. (2012). Pricing Swaptions under Multifactor Gaussian HJM Models. Mathematical Finance Days 2012 Meeting.
27	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2011). Double Barrier Options Valuation under Multifactor Pricing Models. 21st Annual Derivatives Securities and Risk Management Conference.
28	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2011). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. International Conference on Mathematical Finance and Economics.
29	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2010). Double Barrier Options Valuation under Multifactor Pricing Models. 6th World Congress of the Bachelier Finance Society.

30	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2008). Pricing Real Options under the CEV Diffusion. 12th International Conference on Real Options.
31	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2008). Pricing Real Options under the CEV Diffusion. 5th International Conference of the Portuguese Finance Network.

Cargos de Gestão Académica

Director do Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL) (2019 - 2021)
Unidade/Área: Matemática Financeira

Coordenador da unidade curricular Opções Exóticas (2019)
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Investimentos (2019)
Unidade/Área: Finanças

Membro do Plenário da Comissão Científica da Escola de Gestão (2018 - 2022)
Unidade/Área: Plenário da Comissão Científica

Membro da Comissão Permanente da Comissão Científica do Departamento de Finanças (2018 - 2022)
Unidade/Área: Comissão Científica

Coordenador da unidade curricular Fusões, Aquisições e Avaliação de Empresas (2018)
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Investimentos (Mf) (2018)
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Investimentos (2018)
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Modelos, Estrutura Temporal e Taxa de Juro (2018)
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Finanças em Tempo Contínuo (2018)
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Finanças da Empresa para Juristas (2018)
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Opções Exóticas (2018)
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Cálculo Estocástico em Finanças II (2018)
Unidade/Área: Matemática

Coordenador da unidade curricular Equações com Derivados Parciais em Finanças (2018)
Unidade/Área: Matemática

Coordenador da unidade curricular Cálculo Estocástico em Finanças I (2018)
Unidade/Área: Matemática

Coordenador da unidade curricular Investimentos (2018)
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Programação (2018)
Unidade/Área: Matemática

Coordenador da unidade curricular Investimentos (2017)
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Modelos, Estrutura Temporal e Taxa de Juro (2017) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Finanças em Tempo Contínuo (2017) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Métodos Numéricos (2017) Unidade/Área: Matemática
Coordenador da unidade curricular Fusões, Aquisições e Avaliação de Empresas (2017) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Investimentos (Mf) (2017) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Mercados Financeiros (2017) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Teoria da Medida (2017) Unidade/Área: Matemática
Membro do Conselho Geral (2017 - 2021) Unidade/Área: Conselho Geral
Director do Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL) (2017 - 2019) Unidade/Área: Matemática Financeira
Coordenador da unidade curricular Investimentos (2017) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Opções Exóticas (2017) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Modelos, Estrutura Temporal e Taxa de Juro (2016) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Investimentos (2016) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos e Passivos (2016) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Opções Exóticas (2016) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Inovação Financeira e Produtos Estruturados (2016) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Finanças em Tempo Contínuo (2016) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Investimentos (2015) Unidade/Área: Finanças
Coordenador de ECTS do Departamento de Finanças (2015 - 2018) Unidade/Área: Departamento de Finanças
Coordenador da unidade curricular Modelos, Estrutura Temporal e Taxa de Juro (2015) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Finanças em Tempo Contínuo (2015) Unidade/Área: Finanças
Coordenador da unidade curricular Opções Exóticas (2015) Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos e Passivos (2015)
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Inovação Financeira e Produtos Estruturados (2015)
Unidade/Área: Finanças

Subdirector do Departamento de Finanças (2014 - 2018)
Unidade/Área: Departamento de Finanças

Membro do Plenário da Comissão Científica da Escola de Gestão (2014 - 2018)
Unidade/Área: Plenário da Comissão Científica

Membro da Comissão Permanente da Comissão Científica do Departamento de Finanças (2014 - 2018)
Unidade/Área: Comissão Científica

Coordenador da unidade curricular Investimentos (2014)
Unidade/Área: Finanças